

# Webcast

## Formación Estratégica de Portafolios de Inversión

### Descripción

Presentación vía web donde se mostrará desde una perspectiva práctica el uso de herramientas y modelos recientes para formular prudentemente portafolios de inversión incluyendo factores de riesgo de mercado. Además, se mostrarán los principales indicadores estratégicos para la selección de portafolios en relación con el perfil del inversionista.

### Dirigido a

Gerentes Financieros, Analistas de Riesgos, Comisionistas, Administradoras de Fondos de Pensiones y Cesantías, Administradores de Mesas de Dinero, Fideicomisos, Universidades y en general aquellas personas interesadas en una herramienta práctica que permita optimizar y analizar el riesgo de portafolios de inversión aplicando tanto modelos tradicionales de valoración como modernos.

### Objetivo

1. Conocer los fundamentos teóricos y aspectos prácticos del proceso de optimización de portafolios empleando indicadores de riesgo clásicos (simétricos) y modernos (asimétricos).
2. Mostrar la manera eficiente de construir y gestionar portafolios de inversión en una situación real de mercado.

### Temario

1. Estrategias de Inversión.
2. Teoría Moderna de Portafolio.
  - a. Funciones de Utilidad.
  - b. Cálculo de rentabilidad y riesgo.
  - c. Cálculo de covarianzas y correlaciones entre activos.
  - d. Frontera Eficiente.
  - e. Capital Allocation Line (CAL).
3. Principales indicadores estratégicos de inversión.
  - a. Índice de Sharpe.
  - b. Omega de Keating.
  - c. Función de utilidad del inversionista.
  - d. Índice Herfindahl-Hirschman.
  - e. Conditional Value at Risk (CVaR).

### Instructores

#### **Franco Andrés Mansilla Ibañez**

Especialista en entrega de soluciones analíticas a necesidades y problemáticas del negocio, tal como

inversiones, operaciones y riesgos. Académico de la Universidad de Chile en cursos de Riesgo Financiero del Magíster en Finanzas y Métodos Cuantitativo en la gestión de riesgo en el diplomado de Administración de Riesgo. Sus temas de investigación son: eficiencia de mercado, riesgo financiero, machine learning y econometría.

## Información General

### Duración

1 hora

### Fecha de Inicio

Vie. 05 de Oct de 2018

### Horarios

08:00 a.m San José de Costa Rica

09:00 a.m CDMX - Bogotá - Quito - Lima

10:00 a.m La Paz - Caracas

11:00 a.m Buenos Aires - Santiago de Chile

### Herramientas de apoyo



### Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link

<https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora